

B078 信息披露 | Disclosure

汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2020年6月12日更新)

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人：中国民生银行股份有限公司

重要提示

汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会监督委员会2016年12月15日证监许可[2016]3085号文准予注册募集，并于2017年11月6日获得中国证监会证券基金机构监管部《关于同意汇添富民安增益定期开放混合型证券投资基金募集备案的函》（机构部函[2017]2624号）。本基金合同于2018年2月1日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会不对本基金的投资价值及风险做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的价值进行评价或作出投资建议。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证本基金投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资者购买基金时，应详细阅读本基金的招募说明书、基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，并承担基金的投资风险。基金管理人投资中出现的各类风险，包括：因宏观经济的波动和变化对基金资产价值和市场前景所造成实质性判断或保证，也不表示

投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的价值进行评价或作出投资建议。

基金管理人根据有关法律、法规的规定，结合对宏观经济形势、政策趋势的判断，对证券市场进行定性分析和定量分析，选择股票将充分反映价值的股票进行投资及组合管理。

4. 资产支持证券投资策略

本基金拟分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和剩余偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动风险。

5. 国债期货投资策略

本基金拟采用套期保值为目的，参与国债期货交易。

本基金将按照法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断，对债券市场进行定性分析和定量分析，选择国债期货流动性、波动率等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

6. 指数化投资策略

本基金拟采用套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金将按照法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断，对证券市场进行定性分析和定量分析，选择股票将充分反映价值的股票进行投资及组合管理。

7. 股票期权投资策略

本基金拟在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制投资决策流程和风险控制等制度，经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管的要求。

8. 债券回购策略

本基金拟在进行债券回购前将建立债券回购投资决策小组，负责债券回购的投资管理的相关事项。

9. 其他

本基金拟在进行其他投资前将建立其他投资决策小组，负责其他投资的投资管理的相关事项。

1.4 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(已成交)总额	262,817,963.15
卖出股票收入(已成交)总额	113,250,975.05

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	中央票据	-	-
3	金融债券	20,452,000.00	34.2
4	企业债券	312,913,972.00	52.32
5	企业短期融资券	50,292,000.00	8.41
6	中期票据	70,380,400.00	11.77
7	短期融资券(可交換債)	4,059,327.50	0.69
8	同业存单	29,100,000.00	4.87
9	其他	-	-
10	合计	497,196,093.00	81.45

1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	041900016	19金企2901	400,000	40,232,000.00	6.73
2	138306	16蒙企02	400,000	40,041,000.00	6.70
3	101900010	19中企交通	300,000	30,834,000.00	5.16
4	101900062	19中企06	300,000	30,519,000.00	5.10
5	156207	19前海02	300,000	30,376,000.00	5.08

注：期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金单位：人民币元

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	041900016	19金企2901	400,000	40,232,000.00	6.73
2	138306	16蒙企02	400,000	40,041,000.00	6.70
3	101900010	19中企交通	300,000	30,834,000.00	5.16
4	101900062	19中企06	300,000	30,519,000.00	5.10
5	156207	19前海02	300,000	30,376,000.00	5.08

注：期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

1.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

金单位：人民币元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	041900016	19金企2901	400,000	40,232,000.00	6.73
2	138306	16蒙企02	400,000	40,041,000.00	6.70
3	101900010	19中企交通	300,000	30,834,000.00	5.16
4	101900062	19中企06	300,000	30,519,000.00	5.10
5	156207	19前海02	300,000	30,376,000.00	5.08

注：期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有货币市场工具投资明细

金单位：人民币元

序号	货币市场工具代码	货币市场工具名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	041900016	19金企2901	400,000	40,232,000.00	6.73
2	138306	16蒙企02	400,000	40,041,000.00	6.70
3	101900010	19中企交通	300,000	30,834,000.00	5.16
4	101900062	19中企06	300,000	30,519,000.00	5.10
5	156207	19前海02	300,000	30,376,000.00	5.08

注：期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有货币市场工具投资明细

1.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权证及权证投资明细

金单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	041900016	19金企2901	400,000	40,232,000.00	6.73
2	138306	16蒙企02	400,000	40,041,000.00	6.70
3	101900010	19中企交通	300,000	30,834,000.00	5.16
4	101900062	19中企06	300,000	30,519,000.00	5.10
5	156207	19前海02	300,000	30,376,000.00	5.08

注：期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权证及权证投资明细

1.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的其他投资明细

金单位：人民币元

序号	投资品种	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	69,185,47		
2	应收证券清算款	-		
3	应收股利	-		
4	应收利息	12,027,226.48		
5	应收申购款	-		
6	其他应收款	-		
7	待摊费用	-		
8	其他	-		
9	合计	12,096,411.96		

注：期末按公允价值